长盛货币市场基金

2014 第二季度报告

基金管理人:长盛基金管理有限公司
基金托管人:兴业银行股份有限公司
报告送出日期:2014年7月18日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年7月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	长盛货币
基金主代码	080011
交易代码	080011
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2005年12月12日
报告期末基金份额总额	1,131,790,822.15份
投资目标	在力争本金安全、保证资产高流动性的基础上,追求高于业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金将根据宏观经济、微观经济运行状况,货币政策和财政政策执行情况,以及货币市场、证券市场运行状况制定投资策略。采用积极的投资策略,通过动态调整优化投资组合,追求当期收益最大化。在动态调整过程中,基金管理小组将全面考虑收益目标、交易成本、市场流动性等特征,实现收益与风险的平衡。
业绩比较基准	银行一年定期存款利率(税后)。
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中高流动性、低风险的品种,其预期风险和预期收益率都低于股票、债券和混合型基金。
基金管理人	长盛基金管理有限公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2014年4月1日 - 2014年6月30日)
1. 本期已实现收益	19,321,505.71
2.本期利润	19,321,505.71
3.期末基金资产净值	1,131,790,822.15

注:1、所列数据截止到2014年6月30日。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

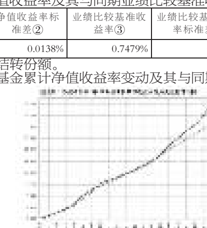
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.3135%	0.0138%	0.7479%	0.0000%	0.5656%	0.0138%

注:本基金收益分配是按日结转份额。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
贾志敏	本基金基金经理,长盛同禧信用增利债券型证券投资基金基金经理,长盛中信全债指数增强型债券投资基金基金经理,长盛积极配置债券型证券投资基金基金经理,长盛季季红1年期定期开放债券型证券投资基金基金经理,长盛年年收益定期开放债券型证券投资基金基金经理,长盛双月红1年期定期开放债券型证券投资基金基金经理,固定收益部副总监。	2013年2月7日	–	8年	男,1982年3月出生,中国国籍。北京大学经济学硕士。曾在中信银行股份有限公司从事人民币债券资产池组合的日常管理和交易等工作。2012年11月底加入长盛基金管理有限公司,现任固定收益部副总监,长盛货币市场基金(本基金)基金经理,长盛同禧信用增利债券型证券投资基金基金经理,长盛中信全债指数增强型债券投资基金基金经理,长盛积极配置债券型证券投资基金基金经理,长盛季季红1年期定期开放债券型证券投资基金基金经理,长盛年年收益定期开放债券型证券投资基金基金经理,长盛双月红1年期定期开放债券型证券投资基金基金经理。
段鹏	本基金基金经理,长盛添利30天理财债券型证券投资基金基金经理,长盛添利60天理财债券型发起式证券投资基金基金经理。	2014年4月10日	–	7年	男,1982年12月出生,中国国籍。中央财经大学经济学硕士。曾在中信银行股份有限公司从事人民币货币市场交易、债券投资及流动性管理等工作。2013年12月加入长盛基金管理有限公司,现任长盛货币市场基金(本基金)基金经理,长盛添利30天理财债券型证券投资基金基金经理,长盛添利60天理财债券型发起式证券投资基金基金经理。

注:1、上表基金经理的任职日期和离任日期均指公司决定确定的聘任日期和解聘日期;

2、"证券从业年限"中"证券从业"的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其各项实施准则、本基金基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定,依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制投资风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内,公司严格执行《公司公平交易细则》各项规定,在研究、投资授权与决策、交易执行等各个环节,公平对待旗下所有投资组合,包括公募基金、社保组合、特定客户资产管理组合等。具体如下:

研究支持,公司旗下所有投资组合共享公司研究部门研究成果,所有投资组合经理在公司研究平台上拥有同等权限。

投资授权与决策,公司实行投资决策委员会领导下的投资组合经理负责制,各投资组合经理在投资决策委员会的授权范围内,独立完成投资组合的管理工作。各投资组合经理遵守投资信息隔离墙制度。

交易执行,公司实行集中交易制度,所有投资组合的投资指令均由交易部统一执行委托交易。交易部依照《公司公平交易细则》的规定,场内交易,强制开启恒生交易系统公平交易程序;场外交易,严格遵守相关工作流程,保证交易执行的公平性。

投资管理行为的监控与分析评估,公司风险管理部、监察稽核部,依照《公司公平交易细则》的规定,持续、动态监督公司投资管理全过程,并进行分析评估,及时向公司管理层报告发现问题,保障公司旗下所有投资组合均被公平对待。

公司对过去4 个季度的同向交易行为进行数量分析,计算溢价率、贡献率、占优比等指标,使用双边90%置信水平对1 日、3 日、5 日的交易片段进行T 检验,未发现违反公平交易及利益输送的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易共有4次,为指数基金被动跟踪标的指数和其他组合发生的反向交易。

本报告期内,未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

1、报告期内行情回顾

二季度,随着稳增长政策的逐步实施,经济基本面出现企稳迹象,但总体仍相对疲弱,通胀水平处于相对低位,定向放松的货币政策及宽松的资金面驱动债券市场走出一波牛市行情。利率债方面,收益率明显下行,其中长端收益率下行幅度大于短端收益率。信用债方面,收益率曲线整体下行,其中低评级债券收益率下行幅度小于中高评级债券,主要是受信用风险事件频发及交易所高风险债券质押回购标准变动等不利影响所致。

货币市场方面,受央行公开市场操作趋于温和及定向宽松的货币政策影响,市场流动性保持相对宽松局面,各中短期限Shibor利率及银行间质押式回购利率均保持在较低水平。

2、报告期内本基金投资策略分析

在报告期内,本基金始终控制配置节奏,根据市场变动调整组合久期,优化持仓结构,保持组合流动性。同时,密切关注高收益债券的信用风险暴露,严格控制其持仓比例,防控信用风险。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2014年2季度,长盛货币净值收益率为1.3135%,同期业绩比较基准收益率0.7479%。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	544,920,883.92	43.94
	其中:债券	544,920,883.92	43.94
	资产支持证券	–	–
2	买入返售金融资产	–	–
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	–	–
3	银行存款和结算备付金合计	672,208,896.36	54.21
4	其他资产	22,959,433.52	1.85
5	合计	1,240,089,213.80	100.00

注:本报告期内,根据流动性管理的需要,本基金提前支取了部分可提前支取且没有利息损失的存款。

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	8.15	
	其中:买断式回购融资	–	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	105,929,747.03	9.36
	其中:买断式回购融资	–	–

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占基金资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

注:本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	139
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	143
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	84

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

注:报告期内无投资组合平均剩余期限超过180天情况。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	20.52	9.36
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
2	30天(含)-60天	15.90	–
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
3	60天(含)-90天	25.18	–
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	1.77	–
4	90天(含)-180天	12.36	–
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
5	180天(含)-397天(含)	33.58	–
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
	合计	107.54	9.36

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	–	–
2	央行票据	–	–
3	金融债券	119,931,391.43	10.60
	其中:政策性金融债	119,931,391.43	10.60
4	企业债券	–	–
5	企业短期融资券	424,989,492.49	37.55
6	中期票据	–	–
7	其他	–	–
8	合计	544,920,883.92	48.15
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	20,039,407.71	1.77

5.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%))
1	130243	13国开43	500,000	49,896,487.04	4.41
2	041453069	14山煤CP001	300,000	30,000,142.03	2.65
3	041452032	14蚌埠CP001	300,000	30,000,136.74	2.65
4	041466014	14鄂长产CP001	300,000	30,000,136.22	2.65
5	041469008	14京纺控CP001	300,000	30,000,103.14	2.65
6	011415001	14中铝业SCP001	300,000	30,000,076.22	2.65
7	130236	13国开36	300,000	29,976,145.02	2.65
8	090205	09国开05	200,000	20,039,407.71	1.77
9	041460052	14津华勘CP001	200,000	20,000,816.68	1.77
10	041460011	14新农资CP001	200,000	20,000,664.78	1.77

5.6 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	6
报告期内偏离度的最高值	0.3399%
报告期内偏离度的最低值	0.0804%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.2102%

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 基金计价方法的说明

本基金的债券投资采用摊余成本法计价,即计价对象以买入成本列示,按票面利率或商定利率每日计提应收利息,并按实际利率法在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价。

5.8.2 本报告期内不存在剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券的摊余成本超过当日基金净值的20%的情况。

5.8.3 本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体无被监管部门立案调查记录,无在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

5.8.4 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	–
2	应收证券清算款	–
3	应收利息	16,335,540.85
4	应收申购款	6,596,535.92
5	其他应收款	27,356.75
6	待摊费用	–
7	其他	–
8	合计	22,959,433.52

5.8.5 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	1,030,509,442.83
报告期期间基金总申购份额	2,527,248,473.60
减:报告期期间基金总赎回份额	2,425,967,094.28
报告期期末基金份额总额	1,131,790,822.15

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注:本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会核准基金募集的文件;

2、《长盛货币市场基金基金合同》;

3、《长盛货币市场基金托管协议》;

4、《长盛货币市场基金招募说明书》;

5、法律意见书;

6、基金管理人业务资格批件、营业执照;

7、基金托管人业务资格批件、营业执照。

8.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

8.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的办公场所及/或管理人互联网站免费查阅备查文件。在支付工本费后,投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人长盛基金管理有限公司。

客户服务中心电话:400-888-2666、010-62350088。

网址:http://www.csfunds.com.cn。

长盛基金管理有限公司
2014年7月18日

长盛积极配置债券型证券投资基金

2014 第二季度报告

基金管理人:长盛基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2014年7月18日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年7月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	长盛积极配置债券
基金主代码	080003
交易代码	080003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年10月8日
报告期末基金份额总额	257,866,880.34份
投资目标	在控制风险和保持资产流动性的基础上,通过积极主动的投资管理,追求基金资产的长期稳定增值,并力争获得超过业绩比较基准的投资业绩。
投资策略	本基金为积极投资策略的债券型基金,不同与传统债券型基金的投资策略特点,本基金在债券类资产配置上更强调积极主动管理。在债券类资产配置上,本基金通过积极投资配置相对收益率较高的企业债、公司债、可转换债、可分离交易可转债、资产支持证券等创新债券品种,并灵活运用组合久期调整、收益率曲线调整、信用利差和相对价值等策略积极把握固定收益证券市场中投资机会,以获取各类债券的超额投资收益。在股票类资产投资上,通过积极投资于一级市场和二级市场高成长性和具有高投资价值的股票,来获取股票市场的积极收益。此外,本基金还积极通过债券回购等手段提高基金资产的流动性和杠杆性用于短期投资于高收益的金融工具。
业绩比较基准	中证全债指数收益率×90%+沪深300指数收益率×10%
风险收益特征	本基金为债券型基金,其长期平均风险和预期收益率低于混合型基金,高于货币市场基金。
基金管理人	长盛基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2014年4月1日 - 2014年6月30日)
1.本期已实现收益	3,929,173.59
2.本期利润	14,221,819.43
3.加权平均基金份额本期利润	0.0511
4.期末基金资产净值	287,920,769.67
5.期末基金份额净值	1.1165

注:1、所述基金业绩指标不包括基金份额持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、所列数据截止到2014年6月30日。

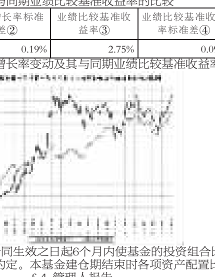
3、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	4.81%	0.19%	2.75%	0.09%	2.06%	0.10%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:按照本基金的基金合同规定,自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同第十二条"(二)投资范围"、"(六)投资限制"的有关约定。本基金建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
贾志敏	本基金基金经理,长盛货币市场基金基金经理,长盛同禧信用增利债券型证券投资基金基金经理,长盛中信全债指数增强型债券投资基金基金经理,长盛季季红1年期定期开放债券型证券投资基金基金经理,长盛年年收益定期开放债券型证券投资基金基金经理,长盛双月红1年期定期开放债券型证券投资基金基金经理,固定收益部副总监。	2013年3月21日	–	8年	男,1982年3月出生,中国国籍。北京大学经济学硕士。曾在中信银行股份有限公司从事人民币债券资产池组合的日常管理和交易等工作。2012年11月底加入长盛基金管理有限公司,现任固定收益部副总监,长盛货币市场基金基金经理,长盛同禧信用增利债券型证券投资基金基金经理,长盛中信全债指数增强型债券投资基金基金经理,长盛积极配置债券型证券投资基金(本基金)基金经理,长盛季季红1年期定期开放债券型证券投资基金基金经理,长盛年年收益定期开放债券型证券投资基金基金经理,长盛双月红1年期定期开放债券型证券投资基金基金经理。

注:1、上表基金经理的任职日期和离任日期均指公司决定确定的聘任日期和解聘日期;

2、"证券从业年限"中"证券从业"的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其各项实施准则、本基金基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定,依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制投资风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内,公司严格执行《公司公平交易细则》各项规定,在研究、投资授权与决策、交易执行等各个环节,公平对待旗下所有投资组合,包括公募基金、社保组合、特定客户资产管理组合等。具体如下:

研究支持,公司旗下所有投资组合共享公司研究部门研究成果,所有投资组合经理在公司研究平台上拥有同等权限。

投资授权与决策,公司实行投资决策委员会领导下的投资组合经理负责制,各投资组合经理在投资决策委员会的授权范围内,独立完成投资组合的管理工作。各投资组合经理遵守投资信息隔离墙制度。

交易执行,公司实行集中交易制度,所有投资组合的投资指令均由交易部统一执行委托交易。交易部依照《公司公平交易细则》的规定,场内交易,强制开启恒生交易系统公平交易程序;场外交易,严格遵守相关工作流程,保证交易执行的公平性。

投资管理行为的监控与分析评估,公司风险管理部、监察稽核部,依照《公司公平交易细则》的规定,持续、动态监督公司投资管理全过程,并进行分析评估,及时向公司管理层报告发现问题,保障公司旗下所有投资组合均被公平对待。

公司对过去4 个季度的同向交易行为进行数量分析,计算溢价率、贡献率、占优比等指标,使用双边90%置信水平对1 日、3 日、5 日的交易片段进行T 检验,未发现违反公平交易及利益输送的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易共有4次,为指数基金被动跟踪标的指数和其他组合发生的反向交易。

本报告期内,未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

1、报告期内行情回顾

二季度,随着稳增长政策的逐步实施,经济基本面出现企稳迹象,但总体仍相对疲弱,通胀水平处于相对低位,定向放松的货币政策及宽松的资金面驱动债券市场走出一波牛市行情。利率债方面,收益率明显下行,其中长端收益率下行幅度大于短端收益率。信用债方面,收益率曲线整体下行,其中低评级债券收益率下行幅度小于中高评级债券,主要是受信用风险事件频发及交易所高风险债券质押回购标准变动等不利影响所致。

货币市场方面,受央行公开市场操作趋于温和及定向宽松的货币政策影响,市场流动性保持相对宽松局面,各中短期限Shibor利率及银行间质押式回购利率均保持在较低水平。

纯债资产以外,2014年二季度A股市场总体处于弱市格局。4月初,受流动性好于预期及相关政策影响,权益市场呈现短暂的反弹;随后,受新股发行重启及上市公司季度业绩表现不佳等因素影响,市场走弱,尤其是创业板相关股票大跌。5月下旬以来,随着稳增长政策的密集出台,加之新股发行数量的明确,权益市场开始呈现反弹走势。受正股反弹行情影响,可转债在二季度总体呈现震荡上涨走势。

2、报告期内本基金投资策略分析

在报告期内,本基金始终控制配置节奏,根据市场变动调整组合久期,优化持仓结构,保持组合流动性。密切关注高收益债券的信用风险暴露,严格控制其持仓比例,防控信用风险。同时,密切关注权益市场变化以及转债个券可能存在的条款博弈机会,调整权益资产占比,择机进行波段操作,有效提升组合收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止报告期末,本基金份额净值为1.1165元,本报告期份额净值增长率为4.81%,业绩比较基准收益率为2.75%。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	22,660,754.65	4.39
	其中:股票	22,660,754.65	4.39
2	固定收益投资	469,567,516.85	90.99
	其中:债券	469,567,516.85	90.99
	资产支持证券	–	–
3	贵金属投资	–	–
4	金融衍生品投资	–	–
5	买入返售金融资产	–	–
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	–	–
6	银行存款和结算备付金合计	10,417,200.14	2.02
7	其他资产	13,405,445.49	2.60
8	合计	516,050,917.13	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	–	–
B	采矿业	–	–
C	制造业	18,112,410.85	6.29
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	–	–
E	建筑业	–	–
F	批发和零售业	–	–
G	交通运输、仓储和邮政业	–	–
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,548,343.80	1.58
J	金融业	–	–
K	房地产业	–	–
L	租赁和商务服务业	–	–
M	科学研究和技术服务业	–	–
N	水利、环境和公共设施管理业	–	–
O	居民服务、修理和其他服务业	–	–
P	教育	–	–
Q	卫生和社会工作	–	–
R	文化、体育和娱乐业	–	–
S	综合	–	–
	合计	22,660,754.65	7.87

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000748	长城信息	433,950	9,837,646.50	3.42
2	002118	紫鑫药业	584,789	8,274,764.35	2.87
3	300339	润和软件	249,909	4,548,343.80	1.58

注:本基金本报告期末仅持有上述三只股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	2,765,233.60	0.96
2	央行票据	–	–
3	金融债券	41,582,000.00	14.44
	其中:政策性金融债	41,582,000.00	14.44
4	企业债券	393,797,043.25	136.77
5	企业短期融资券	–	–
6	中期票据	–	–
7	可转债	31,423,240.00	10.91
8	其他	–	–
9	合计	469,567,516.85	163.09

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	122102	11广汇01	250,000	25,250,000.00	8.77
2	122727	12东胜债	200,000	20,498,000.00	7.12
3	122028	09华发债	180,000	18,180,000.00	6.31
4	112015	09泛海债	171,630	17,202,131.64	5.97
5	113003	重工转债	139,000	15,784,840.00	5.48

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注:本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

注:本基金本报告期末无国债期货投资。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末无国债期货投资。

5.9.3 本期国债期货投资评价

注:本基金本报告期末无国债期货投资。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

吉林紫鑫药业股份有限公司(以下简称"公司"或"紫鑫药业")于2011年10月19日收到中国证券监督管理委员会《调查通知书》(稽查总队调查通字11223号)。因公司涉嫌证券违法违规行为,中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")稽查总队决定对公司立案稽查。详细情况请见公司2011年10月21日发布的《关于中国证监会对公司立案稽查的公告》。2014年2月21日,公司收到中国证监会《行政处罚决定书》[2014]24号,现将《行政处罚决定书》的内容公告如下:依据《中华人民共和国证券法》(以下简称"《证券法》")的有关规定,中国证监会对紫鑫药业信息披露违法违规行为进行了立案调查、审理,并依法向当事人告知了作出行政处罚的事实、理由、依据及当事人依法享有的权利。当事人紫鑫药业、郭春生、曹恩辉、祖春香、殷金龙、李飞、方勇、韩明、徐吉峰未提出陈述、申辩意见,未要求听证。本案现已调查、审理终结。

除上述事项外,本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查记录,无在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

5.10.2

基金的前十名股票,均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	49,771.20
2	应收证券清算款	1,144,172.16
3	应收股利	–
4	应收利息	12,208,918.03
5	应收申购款	2,584.10
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	13,405,445.49

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113003	重工转债	15,784,840.00	5.48
2	110015	石化转债	14,036,100.00	4.87
3	113005	平安转债	1,602,300.00	0.56

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	293,881,297.45
报告期期间基金总申购份额	1,916,419.20
减:报告期期间基金总赎回份额	37,930,836.31
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	–
报告期期末基金份额总额	257,866,880.34

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	50,001,240.00
报告期期间买入/申购总份额	–
报告期期间卖出/赎回总份额	–
报告期期末管理人持有的本基金份额	50,001,240.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	19.39

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注:本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会核准基金募集的文件;

2、《长盛积极配置债券型证券投资基金基金合同》;

3、《长盛积极配置债券型证券投资基金托管协议》;

4、《长盛积极配置债券型证券投资基金招募说明书》;

5、法律意见书;

6、基金管理人业务资格批件、营业执照;

7、基金托管人业务资格批件、营业执照。

8.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

8.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的办公场所及/或管理人网站免费查阅备查文件。在支付工本费后,投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人长盛基金管理有限公司。

客户服务中心电话:400-888-2666、010-62350088。

网址:http://www.csfunds.com.cn。

长盛基金管理有限公司
2014年7月18日

长盛季季红1年期定期开放债券型证券投资基金

2014 第二季度报告

基金管理人:长盛基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2014年7月18日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年7月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	长盛季季红1年期债券	
基金主代码	000145	
交易代码	000145	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013年6月14日	
报告期末基金份额总额	222,358,335.24份	
投资目标	在严格控制投资风险的基础上,追求基金资产的长期稳定增值,力争获取高于业绩比较基准的投资收益,给投资者带来长期的现金红利收益。	
投资策略	本基金主要投资于固定收益类金融工具,不直接买入股票、权证等权益类金融工具。本基金封闭期的投资组合久期与封闭期剩余期限进行适当匹配。本基金的投资策略包括大类资产配置策略、债券组合管理策略和期限管理策略。 本基金将在综合判断宏观经济周期、市场资金供需状况、大类资产估值水平对比的基础上,结合政策分析,确定不同投资期限内的大类金融资产配置和债券类属配置。同时通过严格风险评估,及时调整资产组合比例,保持资产配置风险、收益平衡,以稳健提升投资组合回报。 由于本基金封闭期为一年,基金规模相对稳定,但在开放期内本基金规模的不确定性增强。本基金将采用期限管理策略,分散化投资于不同剩余期限标的,临近开放期时,在最大限度保证收益的同时将组合剩余期限降低,保证开放期内具备足够流动性应对可能发生的组合规模变化。	
业绩比较基准	一年期银行定期存款税后收益率。	
风险收益特征	本基金为债券型基金,属证券投资基金中的较低风险品种,其长期平均预期风险和预期收益率低于股票型基金和混合型基金,高于货币市场基金。	
基金管理人	长盛基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
下属两级基金的基金简称	长盛季季红1年期债券A	长盛季季红1年期债券C
下属两级基金的交易代码	000145	000146
报告期末下属两级基金的份额总额	180,439,407.87份	41,918,927.37份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2014年4月1日 - 2014年6月30日)	
	长盛季季红1年期债券A	长盛季季红1年期债券C
1.本期已实现收益	16,548,912.02	10,430,692.99
2.本期利润	25,521,800.59	16,360,708.66
3.加权平均基金份额本期利润	0.0348	0.0317
4.期末基金资产净值	184,615,758.16	42,880,887.31
5.期末基金份额净值	1.023	1.023

注:1、所述基金业绩指标不包括基金份额持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、所列数据截止到2014年6月30日。

3、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

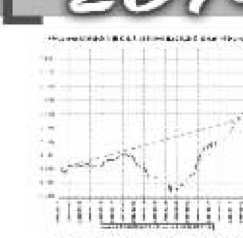
长盛季季红1年期债券A

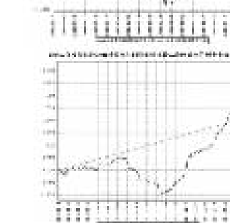
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	4.61%	0.10%	0.73%	0.01%	3.88%	0.09%

长盛季季红1年期债券C

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	4.52%	0.11%	0.73%	0.01%	3.79%	0.10%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较





注:按照本基金基金合同规定,本基金基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。建仓期结束时,本基金的各项资产配置比例符合本基金合同第十三部分(二)投资范围、(五)投资限制的有关约定。截至报告日,本基金的各项资产配置比例符合基金合同约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
贾志敏	本基金基金经理,长盛货币市场基金基金经理,长盛同禧信用增利债券型证券投资基金基金经理,长盛中信全债指数增强型债券投资基金基金经理,长盛积极配置债券型证券投资基金基金经理,长盛年年收益定期开放债券型证券投资基金基金经理,长盛双月红1年期定期开放债券型证券投资基金基金经理,固定收益部副总监。	2013年6月14日	–	8年	男,1982年3月出生,中国国籍。北京大学经济学硕士。曾在中信银行股份有限公司从事人民币债券资产池组合的日常管理和交易等工作。2012年11月底加入长盛基金管理有限公司,现任固定收益部副总监,长盛货币市场基金基金经理,长盛同禧信用增利债券型证券投资基金基金经理,长盛中信全债指数增强型债券投资基金基金经理,长盛积极配置债券型证券投资基金基金经理,长盛季季红1年期定期开放债券型证券投资基金(本基金)基金经理,长盛年年收益定期开放债券型证券投资基金基金经理,长盛双月红1年期定期开放债券型证券投资基金基金经理。

注:1、上表基金经理的任职日期和离任日期均指公司决定确定的聘任日期和解聘日期;

2、"证券从业年限"中"证券从业"的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其各项实施准则、本基金基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定,依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制投资风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内,公司严格执行《公司公平交易细则》各项规定,在研究、投资授权与决策、交易执行等各个环节,公平对待旗下所有投资组合,包括公募基金、社保组合、特定客户资产管理组合等。具体如下:

研究支持,公司旗下所有投资组合共享公司研究部门研究成果,所有投资组合经理在公司研究平台上拥有同等权限。

投资授权与决策,公司实行投资决策委员会领导下的投资组合经理负责制,各投资组合经理在投资决策委员会的授权范围内,独立完成投资组合的管理工作。各投资组合经理遵守投资信息隔离墙制度。

交易执行,公司实行集中交易制度,所有投资组合的投资指令均由交易部统一执行委托交易。交易部依照《公司公平交易细则》的规定,场内交易,强制开启恒生交易系统公平交易程序;场外交易,严格遵守相关工作流程,保证交易执行的公平性。

投资管理行为的监控与分析评估,公司风险管理部、监察稽核部,依照《公司公平交易细则》的规定,持续、动态监督公司投资管理全过程,并进行分析评估,及时向公司管理层报告发现问题,保障公司旗下所有投资组合均被公平对待。

公司对过去4 个季度的同向交易行为进行数量分析,计算溢价率、贡献率、占优比等指标,使用双边90%置信水平对1 日、3 日、5 日的交易片段进行T 检验,未发现违反公平交易及利益输送的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易共有4次,为指数基金被动跟踪标的指数和其他组合发生的反向交易。

本报告期内,未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

1、报告期内行情回顾

二季度,随着稳增长政策的逐步实施,经济基本面出现企稳迹象,但总体仍相对疲弱,通胀水平处于相对低位,定向放松的货币政策及宽松的资金面驱动债券市场走出一波牛市行情。利率债方面,收益率明显下行,其中长端收益率下行幅度大于短端收益率。信用债方面,收益率曲线整体下行,其中低评级债券收益率下行幅度小于中高评级债券,主要是受信用风险事件频发及交易所高风险债券质押回购标准变动等不利影响所致。

货币市场方面,受央行公开市场操作趋于温和及定向宽松的货币政策影响,市场流动性保持相对宽松局面,各中短期限Shibor利率及银行间质押式回购利率均保持在较低水平。

2、报告期内本基金投资策略分析

在报告期内,本基金始终控制配置节奏,根据市场变动调整组合久期,优化持仓结构,保持组合充足的流动性,顺利应对了6月下旬开放期间的申购和赎回。同时,密切关注高收益债券的信用风险暴露,严格控制其持仓比例,防控信用风险。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止报告期末,长盛季季红1年期债券A的基金份额净值为1.023元,本报告期份额净值增长率为4.61%,同期业绩比较基准增长率为0.73%。

截止报告期末,长盛季季红1年期债券C的基金份额净值为1.023元,本报告期份额净值增长率为4.52%,同期业绩比较基准增长率为0.73%。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	–	–
	其中:股票	–	–
2	固定收益投资	321,973,877.50	78.89
	其中:债券	321,973,877.50	78.89
	资产支持证券	–	–
3	贵金属投资	–	–
4	金融衍生品投资	–	–
5	买入返售金融资产	8,800,002.10	2.16
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	–	–
6	银行存款和结算备付金合计	13,107,119.27	3.21
7	其他资产	64,262,251.78	15.75
8	合计	408,143,250.65	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有股票。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

注:本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	–	–
2	央行票据	–	–
3	金融债券	–	–
	其中:政策性金融债	–	–
4	企业债券	321,973,877.50	141.53
5	企业短期融资券	–	–
6	中期票据	–	–
7	可转债	–	–
8	其他	–	–
9	合计	321,973,877.50	141.53

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	122682	12营口债	315,000	32,949,000.00	14.48
2	124193	13文城资	295,890	29,293,110.00	12.88
3	122545	12蒙高新	265,010	26,967,417.60	11.85
4	122727	12东胜债	256,670	26,306,108.30	11.56
5	124318	13滨城投	260,000	25,688,000.00	11.29

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注:本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末无国债期货投资。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末无国债期货投资。

5.9.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体无被监管部门立案调查,无在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

5.10.2

基金投资的前十名股票,均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	59,815.26
2	应收证券清算款	53,779,878.22
3	应收股利	–
4	应收利息	8,763,689.47
5	应收申购款	1,658,868.83
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	64,262,251.78

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末未持有股票。

5.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	长盛季季红1年期债券A	长盛季季红1年期债券C
报告期期初基金份额总额	811,480,378.28	584,523,231.43
报告期期间基金总申购份额	91,105,703.21	6,712,704.22
减:报告期期间基金总赎回份额	722,146,673.62	549,317,008.28
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	–	–
报告期期末基金份额总额	180,439,407.87	41,918,927.37

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注:本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注:本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会核准基金募集的文件;

2、《长盛季季红1年期定期开放债券型证券投资基金基金合同》;

3、《长盛季季红1年期定期开放债券型证券投资基金托管协议》;

4、《长盛季季红1年期定期开放债券型证券投资基金招募说明书》;

5、法律意见书;

6、基金管理人业务资格批件、营业执照;

7、基金托管人业务资格批件、营业执照。

8.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

8.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的办公场所及/或管理人互联网站免费查阅备查文件。在支付工本费后,投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人长盛基金管理有限公司。

客户服务中心电话:400-888-2666、010-62350088。

网址:http://www.csfunds.com.cn。

长盛基金管理有限公司
2014年7月18日